

26 de Diciembre de 2002 <sup>1</sup>

## INFORME DIARIO DEL MERCADO DE FORWARDS

Según el reporte de los Intermediarios del Mercado Cambiario durante el día se pactó un total de US\$81,6 millones con una devaluación implícita promedio ponderado por monto de 2,3%.<sup>2</sup>

**Cuadro No. 1**  
**Contratos Forwards Pactados**

Rango	Sector Interbancario		Sector Real		Total
	Compras	Ventas	Compras	Ventas	
3 a 14	34,8	43,0	10,0	1,8	44,8
15 a 35	1,7	1,0	-	0,7	1,7
36 a 60	8,0	8,0	-	-	8,0
61 a 90	1,1	4,5	4,5	1,1	5,6
91 a 180	5,5	6,6	1,6	0,5	7,1
> 180	11,1	3,3	3,3	11,1	14,3
<b>Total</b>	<b>62,2</b>	<b>66,4</b>	<b>19,4</b>	<b>15,2</b>	<b>81,6</b>

\* Cifras en millones de dólares

**Cuadro No. 2**  
**Devaluación Implícita Anualizada**

Rango	Promedio Simple	Promedio Ponderado por Monto
3 a 14	6,4 %	-0,5 %
15 a 35	5,6 %	4,1 %
36 a 60	5,2 %	5,0 %
61 a 90	2,8 %	6,8 %
91 a 180	4,4 %	5,4 %
> 180	4,2 %	5,8 %
<b>Total</b>	<b>4,9 %</b>	<b>2,3 %</b>

En el cuadro No. 3 se presentan los vencimientos de forwards para ésta y las próximas dos semanas.<sup>3</sup>

**Cuadro No. 3**  
**Vencimientos de Forwards**

Sectores	23 al 27 de Diciembre				30 de Dic. al 3 de Enero				6 al 10 de Enero			
	Delivery		NDF		Delivery		NDF		Delivery		NDF	
	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V	C	V
<b>Interbancario</b>	49	53	288	276	56	67	100	128	45	61	275	258
<b>Real</b>	20	16	178	189	19	8	61	33	22	6	106	123
<b>Total</b>	69	69	466	466	75	75	161	161	67	67	381	381

\* Cifras en millones de dólares

<sup>1</sup> Datos provisionales.

<sup>2</sup> La fórmula para la devaluación implícita es:  $((\text{Tasa Pactada}/\text{Promedio Datatec}) \wedge (\text{Plazo}/360)) - 1$

<sup>3</sup> A partir del 27 de diciembre se presenta la proyección de vencimientos.